

檔 號：
保存年限：

國泰證券投資顧問股份有限公司 函

地址：11047 臺北市信義區信義路5段108號
6樓
傳真：(02)7711-7265

受文者：上海商業儲蓄銀行股份有限公司

發文日期：中華民國109年1月20日
發文字號：國泰投顧字第1090001012號

速別：普通件

密等及解密條件或保密期限：

附件：致單位持有人通知書(中英文)(0001012A00_ATTCH1.pdf)

主旨：謹通知本公司總代理之安盛羅森堡Alpha系列基金致單位
持有人通知書，請查照。

說明：

一、本公司總代理之安盛羅森堡Alpha系列基金公開說明書已
獲基金註冊地主管機關核准，本次更新說明摘要如下：

- (一)更新與中國A股、人民幣清結算及兌換、英國脫歐等風險因素。
- (二)修訂稅務相關資訊，更新英國居民或住民適用之相關稅則。
- (三)更新本基金管理階層背景及基金管理資訊、全球保管網路、託管地址資訊。
- (四)修訂一般投資限制及得自子基金之現金抵押品可投資項目。
- (五)修訂場外交易衍生性工具交易的合格交易對手資格。
- (六)安盛羅森堡泛歐大型企業Alpha基金因達愛爾蘭中央銀行所訂之檢測標準，因此受愛爾蘭中央銀行抽檢並完成主題審查，基於檢查結果已更新以下訊息於公開說明書。

- 1、在投資年限內提供高於該指數年回報率的所有費用/支出總額的大約2%的年投資回報率。
- 2、參照此檔子基金基準並進行管理，亦控制基金與基準之間的背離程度，並將風險程度控制在與基金基準相似之風險程度。
- 3、此檔子基金係積極管理型基金，基金管理人於量化投資過程中將不斷評估基金投資組合中的證券部位，以維持所需的風險收益權衡並實現基金投資目標。

(七)安盛羅森堡泛歐小型企業Alpha基金已清算並關閉之說明。

(八)安盛羅森堡亞太(日本除外)大型企業Alpha基金刪除原先提出之擬投資市場，並將投資策略由全資改為大量投資股本證券。

二、詳細內容敬請參閱境外基金機構致單位持有人通知書。

三、公開說明書及投資人須知已完成更新，可於境外基金資訊觀測站 (<http://announce.fundclear.com.tw>) 中下載或可向本公司索取紙本。

四、如有任何疑義，請聯繫本公司專屬您的服務窗口，或洽張小姐(02)7710-9699分機9625。

正本：國泰人壽保險股份有限公司投資型商品部、國泰世紀產物保險股份有限公司、安聯人壽保險股份有限公司、富邦人壽保險股份有限公司商品行銷部、台灣人壽保險股份有限公司、第一金人壽保險股份有限公司、國際康健人壽保險股份有限公司、宏泰人壽保險股份有限公司、全球人壽保險股份有限公司、國泰證券投資信託股份有限公司、復華證券投資信託股份有限公司、街口證券投資信託股份有限公司、群益證券投資信託股份有限公司、保德信證券投資信託股份有限公司、合作金庫證券投資信託股份有限公司、國泰世華商業銀行股份有限公司信託部、上海商業儲蓄銀行股份有限公司、王道商業銀行股份有限公司、台新銀行理財商品處信託部、群益金鼎證券股份有限公司、凱基證券股份有限公司、元富證券股份有限公司、基富通證券股份有限公司、國泰綜合證券股份有限公司、元富證券投資顧問股份有限公司、元大證券投資顧問股份有限公司、宏遠證券投資顧問股份

公
換
章

有限公司、先鋒證券投資顧問股份有限公司、鉅亨證券投資顧問股份有限公司、
高雄銀行股份有限公司

副本：

2020/01/21
14:20:09

裝

訂

76
線



重要提示：如果您對本通知的內容有任何疑問，請諮詢您的股票經紀人、銀行經理、律師、會計師或其他獨立財務顧問。如果所有單位已被收件人出售或轉讓，則該通知函和任何其他相關文件應轉交給通過其進行銷售或轉讓的人，以便傳送給買方或受讓人。

向安盛羅森堡 Alpha 信託子基金（「基金」）單位持有人發出的通知書

2020 年 1 月 20 日

親愛的基金單位持有人：

本基金的公開說明書已於近日更新並獲愛爾蘭中央銀行核准，茲簡述本次公開說明書更新內容如下，請參照。

本次公開說明書更新說明如下：

1. 修訂本基金之一般基金資料，更新經理人更改指數及規範基準相關內容。
2. 修訂本基金之風險因素，更新與中國 A 股、人民幣清結算及兌換、英國脫離歐盟相關之風險因素。
3. 修訂本基金稅務相關資訊，更新英國居民或住民適用的相關稅則。
4. 更新本基金管理階層背景及基金管理資訊。
5. 更新本基金之全球保管網路及託管地址資訊。
6. 修訂一般投資限制，明訂在同一信貸機構進行的存款和在賬戶中記入並作為輔助流動資金的現金投資，不得超過基金資產淨值的 20% 及信貸機構類別。
7. 修訂得自子基金之現金抵押品可投資的項目：依照愛爾蘭中央銀行 UCITSA 規定第 89 條所定義之短期貨幣市場基金，且在 2019 年 1 月 21 日前投資。
8. 修訂場外交易衍生工具交易的合格交易對手資格，加入以下適格條件：於 2013 年 6 月 26 日根據歐洲議會和理事會第 575/2013 號條例第 107 (4) 條，對信貸機構和投資公司的審慎要求及第 648/2012 號相關修訂法規（即本公開說明書之日：阿根廷，澳大利亞，巴西，加拿大，中國，法羅群島，格陵蘭，根西島，香港，印度，馬恩島，日本的信貸機構，澤西島，墨西哥，摩納哥，新西蘭，沙特阿拉伯，新加坡，南非，瑞士，土耳其或美國）。
9. 安盛羅森堡泛歐大型企業 Alpha 基金：
此檔子基金因達愛爾蘭中央銀行所訂之檢測標準，因此受愛爾蘭中央銀行抽檢並完成主題審查。此次主題審查係有以下發現：
 - (1) 在中央銀行執行的 5 年分析期內，此檔子基金被中央銀行確定為與 MSCI 歐洲低碳領袖淨歐元指數（MSCI Europe Low Carbon Leaders Net EUR Index，以下簡稱「低碳指數」）密切相關。中央銀行使用的指標和門檻是：
 - Tracking Error <3.5%

- Beta 0.9-1.1
 - $R^2 > 0.9$
- (2) 基於檢查結果，此檔子基金的公開說明書及重要投資者訊息文件皆已更新以揭露以下訊息：
- 此檔子基金的目標是在投資年限內提供高於該指數年回報率的所有費用/支出總額的大約2%的年投資回報率。
 - 參照此檔子基金基準並對此檔子基金進行管理；此檔子基金亦控制基金與基準之間的背離程度，並將此檔子基金的風險程度控制至與此檔子基金基準相似之風險程度。
 - 此檔子基金係積極管理型基金，基金管理人於量化投資過程中將不斷評估基金投資組合中的證券部位，以維持所需的風險收益權衡並實現基金的投資目標。

10. 安盛羅森堡泛歐小型企業 Alpha 基金：此檔子基金已清算並關閉。

11. 安盛羅森堡亞太（日本除外）大型企業 Alpha 基金：此檔子基金刪除原先訂定之擬投資市場（新加坡、香港、澳洲、紐西蘭），並將投資策略由全資改為大量投資股本證券。

除非另有說明，本通知函所載的所有資本化條款與信託的基金章程及其他發售文件所載者俱有相同涵義。

您真誠的



董事



董事

代表安盛羅森堡管理愛爾蘭有限公司

IMPORTANT: If you are in any doubt about the contents of this notice, you should consult your stockbroker, bank manager, solicitor, accountant or other independent financial adviser. Where all the securities have been sold or transferred by the addressee, the circular and any other relevant documents should be passed to the person through whom the sale or transfer was effected for transmission to the purchaser or transferee.

NOTICE TO HOLDERS OF UNITS (THE “UNITHOLDERS”)
In the Sub-Funds of AXA Rosenberg Equity Alpha Trust (the “Fund”)

January 20, 2020

Dear Unitholder,

We have updated the prospectus of this Fund and received the approval for the changes from the Central Bank of Ireland (“CBI”). Below please find the summary of the revisions or amendments introduced to the Fund’ s prospectus.

Summary of Changes to the Prospectus

1. We have revised the Change in Index / Benchmarks Regulation in section 4.2.4.
2. We have amended the risk factors to include risks associated with China A share, Clearance and conversion of RMB and Brexit.
3. We have revised the taxation sections applicable to U.K. citizens and residents.
4. We have amended the management and administration information.
5. We have amended the global custody network and depository addresses.
6. We have revised general investment restrictions to prescribe that investment in deposits and cash booked in accounts and held as ancillary liquidity made with the same credit institution shall not exceed 20% of the net asset value of a Fund. We have also revised the categories of credit institution for the described restrictions.
7. We have revised the categories in which the cash collateral received by a sub-fund may not be invested.
8. We have revised eligible counterparties for OTC derivative transactions to include the following: a credit institution in a third country deemed equivalent pursuant to Article 107(4) of the Regulation (EU) No.575/2013 of the European Parliament and of the Council of 26 June 2013 on prudential requirements for credit institutions and investment firms and amending Regulation (EU) No.648/2012 (i.e. as at the date of this Prospectus: a credit institution in Argentina, Australia, Brazil, Canada, China, Faroe Islands, Greenland, Guernsey, Hong Kong,

AXA Rosenberg Management Ireland Limited

78 Sir John Rogerson's Quay, Dublin 2, Ireland

董事：David Cooke (愛爾蘭)、Kevin O'Brien (愛爾蘭)、Jennifer Paterson (英國)、Gideon Smith (英國)、Joseph Pinto (法國)、Josephine Tubbs (英國)、Peter Warner (英國)

於愛爾蘭立案，登記案號 No. 310308，私人股份有限公司

辦公室登記地：78 Sir John Rogerson's Quay, Dublin 2, Ireland

India, Isle of Man, Japan, Jersey, Mexico, Monaco, New Zealand, Saudi Arabia, Singapore, South Africa, Switzerland, Turkey or the USA).

9. With respect to the AXA Rosenberg Pan-European Equity Alpha Fund:

Given that this sub-fund has met the threshold that CBI sets forth, this sub-fund was selected for a thematic review and was mandated to effect necessary revisions or amendments to the Fund' s prospectus to reflect the following findings.

(1) The sub-fund was identified by the CBI as closely moving in line with the MSCI Europe Low Carbon Leaders Net EUR Index (the "Low Carbon Index") over the 5-year period of analysis performed by the CBI. The metrics and thresholds used by the CBI were:

- Tracking Error <3.5%
- Beta 0.9-1.1
- R2 > 0.9

(2) The prospectus is revised and amended to incorporate the following:

- the sub-fund aims to provide an annual return on investment of approximately 2% gross of all fees/expenses above the annual return of the index over the investment horizon.
- the sub-fund is managed with reference to its benchmark, the degree of divergence from its benchmark is controlled and the level of risk of the sub-fund is similar to the risk of its benchmark
- the sub-fund is actively managed and the manager' s quantitative investment process continuously assesses and evaluates the securities in the sub-fund' s portfolio in order to maintain the desired return-to-risk trade off to meet the sub-fund' s investment objective.

10. AXA Rosenberg Pan-European Small Cap Alpha Fund: this sub-fund is now liquidated and closed.

11. AXA Rosenberg Pacific Ex-Japan Equity Alpha Fund: we remove the investment target markets (Singapore, Hong Kong, Australia and New Zealand) of this sub-fund and adjust the investment policy from "fully invested in equity securities" to "substantially invested in equity securities."

Unless otherwise noted, all capitalised terms contained in this notice shall have the same meaning as set out in the Prospectus of the AXA Rosenberg Equity Alpha Trust and the Key Investor Information Document for the Fund.

Yours faithfully



Director



Director

For and on behalf of AXA Rosenberg Management Ireland Limited